

**Abstrak**

Saham di Indonesia mengalami perubahan yang tidak menentu setiap tahunnya dan banyak orang berpikir untuk berinvestasi saham di masa depan. Berinvestasi dalam saham ini menawarkan standar deviasi yang tinggi dan pengembalian yang tinggi. Oleh karena itu, investor harus membangun portofolio untuk menghindari standar deviasi yang tinggi dengan membagi investasi mereka di beberapa saham untuk mendapatkan portofolio yang optimal dengan meminimalkan standar deviasi. Untuk menghindari kondisi perusahaan jatuh pada kebangkrutan, perusahaan perlu melakukan deteksi dini atau prediksi kondisi keuangannya. Beberapa peneliti terdahulu telah melakukan penelitian terkait prediksi financial distress. Mereka memanfaatkan rasio keuangan yang kemudian dianalisis menggunakan analisis diskriminan dan analisis regresi logistik. Pada penelitian ini akan dilakukan Pembentukan Portofolio Saham JII Dengan Mempertimbangkan Prediksi Return Menggunakan Metode Regresi Logistik. Hasil uji eksperimen didapatkan yaitu nilai standar deviasi equal weight menggunakan prediksi lebih kecil dibandingkan nilai standar deviasi equal weight tanpa prediksi yang artinya dengan menggunakan metode equal weight tanpa prediksi dapat memperkecil nilai standar deviasi yang didapat, dengan nilai kekayaan sebesar 1564,278 atau sebesar 156427,8%.

**Kata kunci :** Pembentukan Portofolio, Saham, Prediksi Return, Regresi Logistik, *Standar Deviasi*